

宏利證券投資信託股份有限公司 公告

中華民國 111 年 6 月 10 日

宏投字第 111145 號

主旨：愛德蒙得洛希爾中國基金公說書修訂

說明：

一、依「境外基金管理辦法」第 12 條第 1 項第 6 款規定辦理。

二、有關愛德蒙得洛希爾中國基金（下稱「**本子基金**」）公說書之變更將於 2022 年 7 月 18 日（下稱「**生效日**」）生效。

三、旨揭修訂之內容摘要如下：

1. 針對公開說明書中與本子基金相關之特定部分中「目標與投資政策」作出如下之修正（新增之部分以底線表示，刪除之部分以括號表示〔•〕）（下稱「**本修正**」）

### 目標

本子基金的投資目標是以本基金之資產投資符合環境、社會及公司治理(ESG)標準，其主要業務位於中國之公司股票，以達到本子基金資本超越其基準指標。本子基金採主動式管理。

環境、社會及公司治理（ESG）標準為管理要素之一環，惟其於最終決定中之權重並未事先界定。

### 投資政策與投資限制

本子基金旨在選擇關注良好之環境、社會及公司治理(ESG)風險管理及機會之中國公司。為此，本子基金的投資流程需要採取自有之負責任投資方法，其偏好 ESG 評等良好之公司，無論其資本規模為何，並依賴自有之 ESG 評等或外部之額外金融評等機構提供的評等。至少 90% 之投資組合公司取得 ESG 評等。篩選程序包括透過範圍內最佳法進行之正面篩選以及負面篩選，就此，投資經理公司亦已訂定正式的排除政策以整合與武器、燃料煤及煙草相關之有爭議性公司之排除。因此，合格的投資範圍便減少了 20%，並依據 ESG 標準進行界定。關於適用在本子基金之負責任投資方法之進一步細節，可於投資經理公司網站查閱：<https://www.edmond-de-rothschild.com/site/France/en/asset-management/our->

expertise/socially-responsible-investment，更具體而言，是載於本子基金之透明度準則。

〔投資經理公司將系統性地將環境、社會及公司治理（ESG）因素納入其財務分析，以篩選投資組合之有價證券。〕

投資組合中至少 75% 之公司將具備 ESG 評等。其將為自有之 ESG 評等或由外部之非金融評等機構提供。於此程序結束時，本子基金將具備較其投資範圍更高之 ESG 評等。

此外，有價證券篩選程序亦包含負面篩選，以排除依據國際公約，於該地區致力於爭議性武器製造之公司，以及依據愛德蒙得洛希爾集團（Edmond de Rothschild Group）之排除政策下，從事與燃料煤或菸草相關活動之公司，該等排除政策可於愛德蒙得洛希爾之網頁閱覽。〕

本子基金因提倡 ESG 特徵之結合而被歸類於 SFDR 第 8(1) 條，惟其並未為實現環境或社會特徵之目的而指定一參考指標。

鑑於其 ESG 策略，本子基金提倡環境特徵，但並不投資於環境永續經濟活動。此金融產品之投資並未考量歐盟就環境永續經濟活動之標準。基此，就分類規則而言，「不造成重大損害」之原則並不適用於本子基金下之投資。

本投資策略是根據篩選與動態管理在中國進行其大多數業務之公司證券。本子基金淨資產之 75%-110% 〔將投資於及/或〕曝險於受規管市場交易之公司股票與其他類似證券，且該公司係於中國上市、總部或主要業務在中國者。本子基金可透過滬港通投資中國 A 股及投資在上海與深圳股票交易所上市的中國 B 股，以及在例如香港、紐約、新加坡與臺北等其它股票交易所上市的股權證券。類似證券為 ADR（美國存託憑證）、GDR（全球存託憑證）、P-notes（參與憑證）（除透過 QFII 或 RQFII 額度持有中國 A 股作為標的資產之 P-notes 外）與依 2010 年 12 月 17 日法律第 41.1 條款符合可轉讓證券資格之參與憑證。

本子基金投資的證券範圍，將集中於（包括但不限於）所有產業資本額大於 5 億美元的公司。此外，可投資淨資產之 20% 於小型資本額公司（低於 1 億美元）。本子基金的產業多元性，協助限制投資組合的波動幅度。

本子基金之最高總股票風險擬為淨資產之 110%。

為了管理現金，本子基金最多可投資淨資產之 25% 於可轉讓債務證券、貨幣市場工具與貨幣市場基金。本子基金將尋求於購買時為投資等級的公開或私人發行者之發行品（即該評等高於或相當於標準普爾 BBB- 等級，或其它獨立機構給予的相當評等，或由投資經理公司對未經評等證券視為相當的評等），且僅具三個月內的短期到期日。

本子基金得為達到其投資目標並符合第 5 章「投資限制」所列限制之目的，而使用衍生性金融工具。

此類工具亦得為避險目的使用。該等工具包括但不限於：

- 貨幣遠期合約、貨幣期貨或貨幣交換合約〔，為了就美元、港幣、新加坡幣或人民幣進行避險〕；
- 股票指數期貨合約；或
- 投資最高 25% 的淨資產在有組織或受監管市場進行交易的股票選擇權合約〔，降低股票波動度〕。

本子基金不使用總報酬交換或證券借貸交易。

本子基金可將最高 10% 的淨資產，投資於可轉讓證券集合投資事業或其它投資基金之單位或股份。」

2. 修正公開說明書之一般部份（下稱「一般修正」），尤其是為了（除其他部分外）釐清第 5 段（投資限制）之內容，以反映 2010 年 12 月 17 日法律規定之法規限制，其詳載於修訂版之公開說明書。
3. 若臺端不同意上述第 1 項之變更，臺端可於自本通知之日起至 2022 年 7 月 15 日止之一個月內（「買回通知期間」）免費買回您的股份。買回通知期間內之買回將遵守公開說明書之規定，但無需支付買回費用或收費。
4. 欲獲取關於本通知中任何事項詳細資訊之股東，可於正常營業時間撥打電話愛德蒙得洛希爾系列基金之台灣區總代理-宏利證券投資信託股份有限公司服務電話：0800-070-998。